
"인간은 살아있기 위해 무언가에 대한 열망을 간직해야 한다." - 마가렛 딜란드

One must desire something to be alive.

1.글로벌 증시

* <뉴욕 마감> M&A·실적호조에 기술·은행주 랠리 '또 최고치'

- 일본 스프트뱅크의 ARM홀딩스 인수 소식

- 뱅크오브아메리카, 기대 이상의 실적 호재

-美 부동산지표

7월 NAHB주택가격지수 60 → 59 (예상:60)

* <유럽 마감> 유럽증시, 테러·쿠데타 불구 대형 M&A 소식에 '혼조'

* <상하이 마감> 투자심리 부진에 하락...0.35% ↓

* <도쿄 마감> 일본 '바다의 날' 휴장

DOW30 18533.05 (+0.09%)...닷새째 최고치 행진

NASDAQ 5055.78 (+0.52%)...다시 최고치

S&P500 2166.89 (+0.24%)...다시 최고치

NIKKEI225 16497.85 (0.00%)

SHANGHAI 3043.56 (-0.35%)

FTSE100 6695.42 (+0.39%)

DAX30 10063.13 (-0.04%)

CAC40 4357.74 (-0.34%)

2.글로벌 채권

* <뉴욕 채권> 국채가, 세계 경기 불확실성에도 불구하고 하락

[미국]

2y 0.69% (+2.2bp)

10y 1.58% (+3.1bp)

30y 2.29% (+2.9bp)

[기타 10Y물]

영국 0.82% (-0.9bp)

독일 -0.02% (-2.1bp)

프랑스 0.21% (-1.7bp)

이탈리아 1.25% (-0.4bp)

스페인 1.24% (+1.4bp)

그리스 7.68% (+4.0bp)

3.글로벌 환시

* 달러, 터키 쿠데타 불발로 엔화에 상승

유로/달러 1.1075 (+0.0046)

유로/엔 117.57 (+1.96)

달러/엔 106.14 (+1.31)

달러/위안 6.6961 (+0.0156)

파운드/달러 1.32518 (+0.00676)

NDF 1136.00 / 1136.70원...0.50원 하락

4.글로벌 상품

* <국제 유가> 국제유가, 美 원유재고 증가에 하락...WTI 1.6% ↓

* <국제 금값> 호약재 공방 속 0.1% 상승

- 미국 달러화가 유로화와 영국 파운드화에 약세를 보였으나 터키 쿠데타 실패에 따른 안전자산 매입세 약화로 소폭 상승

WTI 45.24 (-1.60%)

COMEX금 1329.30 (+0.10%)

5. 전일 국내 지표

코스피 2021.11 (+0.19%)

코스닥 700.90 (+0.09%)

원/달러 1138.30, 전일(1135.00원)

KTB: 시가 111.09 / 종가 111.08

LKTB: 시가 133.36 / 종가 133.37

한국 생산자 물가지수(MoM) (발표:0.2%, 이전:0.1%)

한국 생산자 물가지수(YoY) (발표:-2.7%, 이전:-3.0%)

6. 전일 국내 주요 금리 : 국채 금리는 상승 마감. 국채 10년물 입찰등이 부진함에 따라 어제의 약세장을 이어감. 다만 장중 변동폭은 제한되었으며, 국채선물은 시가대비 보합 수준 마감.

3y 1.229% (+0.8bp)

5y 1.253% (+1.2bp)

10y 1.415% (+2.3bp)

CD 1.360% (0bp)

7. 본드-스왑 스프레드

3y	-2.7bp	(+0.2bp)
5y	-4.1bp	(+0.8bp)
10y	-14.5bp	(+0.5bp)

8. IRS/CRS 동향

* IRS: IRS 금리는 상승 마감. 채권 시장과 연동하여 시장은 약세를 보였으며, 국채 10년 입찰 역시 부진하며 약세폭을 확대. 그러나 3년과 10년 국채선물은 시가 대비 보험권에 마감. IRS 커브는 역전되었던 구간에서 다시 커브를 되돌리는 모습.

1Y	1.2475%	(+0.75bp)
2Y	1.2075%	(+0.75bp)
3Y	1.2025%	(+1.00bp)
5Y	1.2125%	(+2.00bp)
7Y	1.2250%	(+2.25bp)
10Y	1.2700%	(+2.75bp)

1*2Y	-4.00	(0bp)
2*3Y	-0.50	(+0.25bp)
2*5Y	0.50	(+1.25bp)
3*5Y	1.00	(+1.00bp)
5*7Y	1.25	(+0.25bp)
5*10Y	5.75	(+0.75bp)

9. 주요뉴스

[해외]

* 일본 소프트뱅크, ARM홀딩스 인수

- 손정의 회장이 이끄는 소프트뱅크는 ARM 주식을 주당 17파운드에 인수. 총 인수 가격은 243억파운드(약 36조150억원)로 유럽 IT 분야 M&A 가운데 최대 규모.

-ARM은 영국 반도체 설계업체로 세계 최고 수준의 모바일 기기용 중앙처리장치(CPU) 설계 기술을 보유.

* 블라드 세인트루이스연은 총재, 은행 과도한 규제 경쟁력 약화 우려

* S&P "中 올해 경제성장률 전망 6.6%로 상향"

-예상 중국 경제 성장률, 2016년 6.6%, 2017년 6.3%

* BOE 위원 "다음 달 기준금리 인하 확정 아니야"

* 브렉시트 결정 후 영국 기업 M&A 활발...파운드화 급락 덕(?)

- 18일 브렉시트 결정 후 영국 파운드화가 급락세를 보임에 따라 영국 기업 인수 가격 매력이 높아졌지만, 대부분의 인수 논의는 브렉시트 투표 전부터 진행됐으며 가격 매력이 영국 기업 인수 를 모두 설명해줄 수 없다고 진단 <다우존스>

* 무디스, 터키 신용등급 하향 검토 대상

-터키 현재 신용등급은 'Baa3'

-쿠데타 시도가 실패하긴 했지만, 터키의 전반적인 정치적인 문제들이 높은 수준의 신용 위험과도 관련이 있다고 평가.

[국내]

* 국금센터 "위안화 추가절하 가능성...환율 불안 재현 우려"

* 채권시장 "국고 10년 입찰 무난...장투기관·PD 수요"

* 금리인하 반영안된 회사채 스프레드...강세장 나오나

* 도이치銀 "하반기도 저가매수 이어질 것"

* 6월 생산자물가, 유가 상승 탓...3개월째 ↑

****금일 예정 지표****

[RBA 통화정책회의 의사록]

미국-6월 건축허가(MoM) (이전:0.7%, 예상:0.6%)

-6월 주택착공(MoM) (이전:-0.3%, 예상:0.5%)

영국-6월 CPI(MoM) (이전:0.2%, 예상:0.21%)

독일-7월 ZEW경기신뢰지수 (이전:19.2, 예상:9.0)